

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE FELIZ/RS  
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL  
COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS

**RELATÓRIO E PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS – FELIZ/RS**  
**RENTABILIDADE, RISCOS E ADERÊNCIA DAS ALOCAÇÕES À POLÍTICA DE INVESTIMENTOS**

**Ao Conselho Fiscal do RPPS – Feliz/RS**

Em atendimento ao disposto no Art. 23-A, Inciso VIII, da Lei Municipal nº 1.809/2005, bem como requisito do nível I do Pró-Gestão RPPS, apresentamos o presente relatório com a rentabilidade, controle de riscos e aderência das alocações à Política de Investimentos aprovada pelo Conselho Municipal de Previdência deste RPPS, em relação ao mês de agosto de 2019.

**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	34.700.185,49	848.368,99	734.139,51	35.661.603,12	847.188,15	2,43%	0,83%	292,61%	1,59%
Fevereiro	35.661.603,12	451.811,19	797.235,62	35.360.716,13	44.537,44	0,12%	0,90%	13,95%	1,96%
Março	35.360.716,13	848.362,29	684.157,45	35.701.837,05	176.916,08	0,50%	1,19%	41,72%	2,41%
Abril	35.701.837,05	3.869.416,51	3.896.879,82	36.025.977,13	351.603,39	0,98%	1,06%	92,95%	1,47%
Mai	36.025.977,13	312.132,22	600.000,00	36.481.245,38	743.136,03	2,06%	0,64%	321,98%	1,93%
Junho	36.481.245,38	2.333.568,37	2.033.800,00	37.712.137,35	931.123,60	2,53%	0,45%	562,14%	1,91%
Julho	37.712.137,35	1.802.915,11	1.797.200,79	38.199.904,74	482.053,07	1,28%	0,72%	176,47%	1,37%
Agosto	38.199.904,74	400.211,86	1.487.316,51	37.062.526,78	-50.273,31	-0,13%	0,62%	-21,21%	2,05%
Acumulado no ano					3.526.284,45	10,17%	6,60%	154,17%	

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (agosto/2019)**

Artigos	Resolução %	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.350.453,74	44,12%	25,00%	40,00%	70,00%	9.593.315,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	11.035.206,73	29,77%	5,00%	10,00%	60,00%	11.202.309,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	5.494.468,81	14,82%	10,00%	20,00%	40,00%	9.330.541,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.084.875,57	2,93%	5,00%	10,00%	20,00%	6.327.629,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.380.887,08	6,42%	5,00%	10,00%	10,00%	1.325.365,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.853.126,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	716.634,85	1,93%	0,00%	5,00%	5,00%	1.136.491,49
Total Carteira		37.062.526,78					

**Distribuição de rendimentos de Fundos Imobiliários - base (agosto/2019)**

Fundo	Valor (R\$)	Nº Cotas	Retorno (R\$)
BNFS11	0,9126215714	3.665	3.344,75
RBVA11	9,00	100	900,00
CXRI11	7,00	100	700,00
Total			4.944,75

Atestamos que estão sendo realizados os controles de risco de mercado, de crédito e de liquidez previstos na Política de Investimentos. De qualquer sorte, é importante ressaltar que, seja qual for à alocação de ativos, o mercado apresentar períodos adversos, que poderão afetar parte da carteira. Portanto, é imperativo observar um horizonte de tempo que possa ajustar essas flutuações e permitir a recuperação da ocorrência de ocasionais perdas. Desta forma, o RPPS deve manter-se fiel à política de investimentos definida originalmente, a partir do seu perfil de risco.

**Observações:**

- Deve-se atentar para que as receitas de contribuição sejam maiores que as despesas com benefícios. Em agosto/19 identificamos um valor de contribuição de R\$ 33.796,31 inferior à despesa.

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE FELIZ/RS  
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL  
COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS

- Ocorreu o desenquadramento passivo no Fundo BB Pipe FIC Ações, por termos ultrapassado 15% do Patrimônio Líquido do Fundo, cujo limite está estabelecido no Art. 14 da Resolução 3922. Ciente desta situação a Gestão Financeira promoveu, em 29/08/2019, o resgate da totalidade do fundo. Contudo, não está registrado na carteira o valor de R\$ 1.126.490,07, visto a disponibilidade ser d+3.

Feliz/RS, 16 de setembro de 2019.

<b>Membro Titular:</b>	<b>Membro Titular:</b>	<b>Gestor Financeiro:</b>
<p><b>Tatiane Schnur</b> CPF: 003.762.150-54 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 12/06/2021</p>	<p><b>Eduardo Mello da Silva</b> CPF: 002.796.350-01 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 25/10/2020</p>	<p><b>Ramsés Machado Silva</b> CPF: 964.688.900-04 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 02/06/2020</p>

\* A ata eletrônica é cópia fiel da ata impressa, que pode ser conferida junto ao Gestor Financeiro do RPPS.